

ИНФОРМАЦИЯ

СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 48, АЛ. 3 ОТ НАРЕДБА № 25,

**ИЗГОТВЕНА ОТ УД „СТАТУС КАПИТАЛ” АД
ОТНОСНО ПОРТФЕЙЛА
НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СТАТУС ФИНАНСИ”**

ЗА ПЕРИОДА от 01.6.2011 г. до 30.6.2011 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец юни нетните активи на Статус Финанси са 981612.66 лв., което представлява намаление с 36 091.43 лв. спрямо края на месец май. Броят на емитираните дялове намалява със 16 968.22 и достига 2 446 964.79 бр.



Горната графика представя движението на индекса CECE BNK представящ движението на акции на банки от Източна Европа, съчетан с движението на Статус Финанси.

След като през май най-добре представящите се акции на финансови компании бяха тези от Сърбия, през юни напрежението, свързано с гръцката криза, достигна и до тях, като сръбските банки се оказаха с най-висок отрицателен принос за спада на ДФ Статус Финанси. Тъй като краткосрочното решение на дълговата криза в Европа е по-скоро плод на политически преговори, отколкото на пазарни такива е трудно да се прогнозира какви ще са ефектите спрямо пазарите. Все пак, овладяването на прехвърлянето на проблемите и върху други пазари ще се отрази позитивно и на котировките на банковите компании. В същото време опасността при подобно заразяване е значителна, като дори само рискът това да се случи е достатъчен за да оказва силен натиск върху пазарите в краткосрочен срок.

| Изменение | Q3 2009 | Q4 2009 | Q1 2010 | Q2 2010 | Q3 2010 | Q4 2010 | Q1 2011 | Q2 2011 | Юни 2011 |
|-------------------------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|----------|
| ДФ Статус Финанси | 28.53% | -5.94% | 8.27% | -11.26% | 5.9% | 0.05% | 0.7% | -7.5% | -2.9% |
| CECE Banking Financial Index | 47.72% | 5.4% | 14.79% | -18.74% | 16.8% | 5.7% | 2.96% | -2.45% | -2.04% |

Стандартно отклонение

| | Стандартно отклонение |
|------------------------------|-----------------------|
| ДФ Статус Финанси | 11.24% |
| CECE Banking Financial Index | 17.68% |

Продажби и покупки на ценни книжа

През месеца не сме извършвали сделки с ценни книжа

Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период в лева

| Активи | 30.4.2011 | 31.5.2011 | 30.6.2011 | Структура на активите спрямо общата им стойност /%/ |
|--------------------|------------------|------------------|----------------|---|
| Акции и права | 879 646 | 835 568 | 808 072 | 82.07% |
| Облигации | - | - | - | - |
| Парични средства | 68 095 | 65 618 | 56 500 | 5.74% |
| Депозити до 3 мес. | 115 865 | 115 865 | 115 865 | 11.77% |
| Вземания | 2 912 | 2 831 | 3 317 | 0.34% |
| Други | 1 221 | 1 047 | 879 | 0.09% |
| Общо: | 1 067 739 | 1 020 930 | 984 633 | 100.00% |

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Финанси” акции

| Company | 31.5.2011 | | | 30.6.2011 | | | |
|--------------------------------|------------------|--------------|--------------------|------------------|--------------|--------------------|---------------------|
| | Брой ценни книжа | Цена за брой | Балансова стойност | Брой ценни книжа | Цена за брой | Балансова стойност | Процент от активите |
| София Комерс - заложни къщи АД | 5700 | 6.8 | 38760 | 5700 | 6.908 | 39375.6 | 4.0% |
| Сентинел рапид | 17777.0253 | 1.2067 | 21451.54 | 17777.0253 | 1.2087 | 21487.09 | 2.2% |
| ДФ ОБЩИНСКА БАНКА - БАЛАНСИРАН | 2535.5612 | 12.1107 | 30707.42 | 2535.5612 | 12.1354 | 30770.05 | 3.1% |
| CROATIA OSIGURANJE D.D. | 32 | 1522.43 | 48717.74 | 32 | 1473.12 | 47139.88 | 4.8% |
| JADRANSKO OSIGURANJE D.D. | 59 | 772.51 | 45578.06 | 59 | 692.565 | 40861.35 | 4.1% |
| Privredna Banka Zagreb D.D. | 155 | 156.317 | 24229.13 | 155 | 153.257 | 23754.91 | 2.4% |
| ZAGREBACHKA BANKA D.D. | 85 | 69.87 | 5938.95 | 85 | 76.3645 | 6490.98 | 0.7% |
| SIF OLTENIA CRAIOVA | 45000 | 0.65147 | 29316.13 | 45000 | 0.6365 | 28642.63 | 2.9% |
| Agrobanka a.d. Beograd | 110 | 175.274 | 19280.15 | 110 | 150.014 | 16501.51 | 1.7% |
| AIK banka a.d. Niš | 1236 | 71.9368 | 88913.89 | 1236 | 58.6006 | 72430.33 | 7.4% |
| Dunav Osigurianje A.D. | 258 | 34.2844 | 8845.38 | 258 | 30.541 | 7879.58 | 0.8% |
| Metals Banka AD Novi Sad | 105 | 61.2481 | 6431.05 | 105 | 48.1021 | 5050.72 | 0.5% |
| T. Garanti Bankasi | 10500 | 5.82787 | 61192.65 | 10500 | 6.10885 | 64142.89 | 6.5% |
| İŞ BANKASI (C) | 8400 | 4.13234 | 34711.62 | 8400 | 4.05315 | 34046.42 | 3.5% |
| Haci Omer Sabanci Holding | 7000 | 5.86195 | 41033.67 | 7000 | 5.70936 | 39965.51 | 4.1% |
| Türkiye Halk Bankasia A.S. | 2100 | 9.50011 | 19950.24 | 2100 | 9.98722 | 20973.15 | 2.1% |
| Erste Bank AG | 750 | 66.8307 | 50123.03 | 750 | 68.5518 | 51413.88 | 5.2% |

| | | | | | | | |
|--|------|---------|----------|------|---------|----------|-------|
| Raiffeisen International Bank-Hold. AG | 681 | 73.373 | 49966.99 | 681 | 67.5544 | 46004.52 | 4.7% |
| VIENNA INSURANCE GROUP | 500 | 76.6685 | 38334.27 | 500 | 72.2581 | 36129.07 | 3.7% |
| Allianz SE | 220 | 184.904 | 40678.92 | 220 | 185.628 | 40838.12 | 4.1% |
| NBG | 1200 | 8.66433 | 10397.19 | 1200 | 9.40754 | 11289.05 | 1.1% |
| Piraeus Bank S.A. | 3471 | 1.8776 | 6517.14 | 3471 | 2.09274 | 7263.89 | 0.7% |
| AXA | 1200 | 28.4182 | 34101.85 | 1200 | 29.846 | 35815.16 | 3.6% |
| BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA | 2700 | 15.3865 | 41543.59 | 2700 | 15.4413 | 41691.45 | 4.2% |
| BANCO SANTANDER SA ORD | 2500 | 15.5391 | 38847.67 | 2500 | 15.2457 | 38114.24 | 3.9% |
| Total: | | | 835568 | | | 808072 | 82.1% |

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:
08.07.2011 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: